

2014/10/10(金) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	10日需給速報		14日需給予想	15日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,200	900	1,000
財政		3,200	▲ 23,000	36,000
資金過不足		2,000	▲ 22,100	37,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			1,500	
98,648			▲ 2,800	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				
国庫短期証売却				
国債買入			5,700	
CP等買入				3,600
		▲ 900	▲ 300	
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053				
被災地支援				
3,689				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入				
国債補充供給				
小計		▲ 1,000	4,100	3,600
当預増減		1,000	▲ 18,000	40,600

当座預金残高	1,626,400	10/10以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,489,300		5,100
積み終了先	1,240,900	10/14以降の残り所要積立額	
超過準備	1,239,800	積数	100
非準備先残高	137,100	1日平均	100

積み期間(9/16～10/15)の所要準備額(積数)	1,856,200
準備預金進捗率	99.99% (実績) 93.33% (日数)

10/9のマネタリーベース	2,534,200
10/9コール 合計	167,628 無担 59,876 有担 107,752
コール前日増減 計	▲ 4,156 無担 ▲ 2,436 有担 ▲ 1,720

10/10 の加重平均レート(速報)				10/9 の加重平均レート(確報)				単位 (%)
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国	O/N	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.030 ～0.135 (0.060)	0.030 ～0.040 (0.031)			0.045 ～0.135 (0.059)			0.030 ～0.040 (0.031)	
0.062 ～0.120 (0.085)				T/N		0.065 ～0.120 (0.079)		
				S/N				
0.093 ～0.400 (0.140)				1W		0.340 (0.340)		
				2W		0.330 (0.330)		
				3W				
0.070 ～0.300 (0.089)		0.08-0.12	-	1M		0.116 ～0.145 (0.132)	有担先日付分	
		0.08-0.12	0.011～0.015	2M				
		0.08-0.12	▲0.010～▲0.007	3M		0.075 (0.075)		
		-	▲0.001	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,000億円	10/10	～	10/14 (4日間)	応札	4億円	落札	4億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国債補完	302億円	10/10	～	10/14 (4日間)	応札	1億円	落札	1億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)

T-Bill2M 応札13兆9,209億2,000万円 落札2兆3,87億5,000万円(非競争入札:1,812億円) 10/15～12/3 0.0111% 按分89.7414% 平均0.0081%

流動性供給 応札 7,350億円 落札 2,990億円 10/15 募入最大利回較差 0.004% 按分 75.4672% 募入平均利回較差 0.001%

ETF買入 147億円 約定日 10/10

J-REIT買入 8億円 約定日 10/10

<< 10/14の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,608,400	前日比	▲ 18,000
O/N	0.05～0.07	T/N	0.05～0.12	S/N	0.05～0.12

無担O/Nは、0.06%近辺での出合いが中心になると見込まれる。

<< 10日のインターバンク市場動向 >>

午前8時発表の準備預金残高見込みは、124兆9,000億円(当座預金残高見込みは162兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀・信託業態から0.056～0.058%、大手行からは0.055%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.058～0.06%と昨日よりもやや強めの立ち上がりとなった。一巡後は、調達レートを切り下げ、0.055～0.056%での出合いが数件みられる程度で今週の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行がT+3スタートの1M物0.118%での調達を行った。

<< 10日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは、引き続き横ばいで推移した。短国市場は、2M物の入札が実施された。買入オペの対象とならない可能性が高いものの、品薄感が強く、結果は最高落札利回り0.0111%、按分率89.7414%、平均落札利回り0.0081%と、足切レートはさほど伸びなかった。アウトライトは、2M:0.011～0.015%、3M:▲0.01～▲0.007%、6M:▲0.001%での出合い。CP市場は、発行日が「5・10日」に該当することもあり、大型発行が複数みられた。発行総額は約1,800億円程度。全体的に品薄感が強く、発行レートは若干低下した。

<< 13日の材料 >>

*コロンブスデー(米国市場休場)

<< 14日の材料 >>

*9月のマネーストック

*9月の企業物価指数

*英国9月の消費者物価指数

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	107.82-84
0.500 ▲ 0.015	15,300.55 ▲ 178.38	為替(5時)	108.08-09

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	10/3	10/6	10/7	10/8	10/9	10/10
日銀当預残	1,622,200	1,583,100	1,628,800	1,626,200	1,625,400	1,626,400
準備預金残	1,498,000	1,456,100	1,502,700	1,494,500	1,494,000	1,489,300
レート	0.061%	0.060%	0.059%	0.059%	0.059%	0.060%
月中平均	0.05760%	0.05800%	0.05814%	0.05825%	0.05833%	0.05885%

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。」

金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。

金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目論見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入